

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

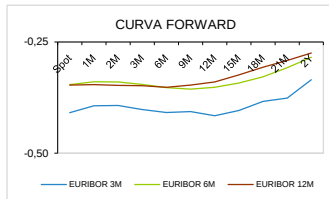
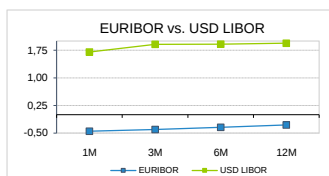
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

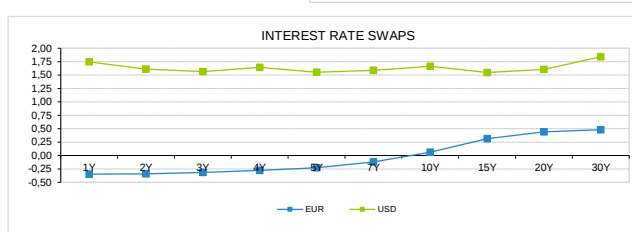
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4480	0	1	1M	1,7016	0	-10	0,7139
3M	-0,4000	0	1	3M	1,9086	-1	-2	0,7916
6M	-0,3420	0	1	6M	1,9143	0	-2	0,8478
12M	-0,2780	0	2	12M	1,9416	0	-1	0,9343
								-0,5264

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3471	0	1	-0,3397	-0,1750	0,0517
2Y	-0,3420	0	2	-0,3092	-0,1227	0,1180
3Y	-0,3150	0	2	-0,2629	-0,0646	0,1850
4Y	-0,2760	0	3	-0,2158	-0,0002	0,2530
5Y	-0,2290	-1	3	-0,1624	0,0634	0,3190
7Y	-0,1190	0	4	-0,0425	0,1915	0,4260
10Y	0,0610	0	4	0,1388	0,3515	0,5510
15Y	0,3130	0	5	0,3575	0,5046	0,6408
20Y	0,4430	1	5	0,4616	0,5555	0,6283
30Y	0,4810	1	5	0,4670	0,5128	0,5438

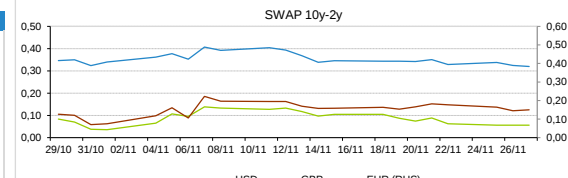
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7450	2	0	1,4831	1,4980	1,6497
2Y	1,6100	2	-1	1,4749	1,5375	1,6614
3Y	1,5650	2	-2	1,4965	1,5670	1,7152
4Y	1,6430	6	11	1,5030	1,6141	1,7536
5Y	1,5540	1	-2	1,5393	1,6350	1,7901
7Y	1,5870	2	-2	1,5860	1,6960	1,8210
10Y	1,6650	1	-3	1,6905	1,7757	1,8852
15Y	1,5480	-8	9	1,7560	1,8360	1,8920
20Y	1,6040	-7	9	1,8155	1,8550	1,9050
30Y	1,8400	0	-4	1,8290	1,8694	1,8740

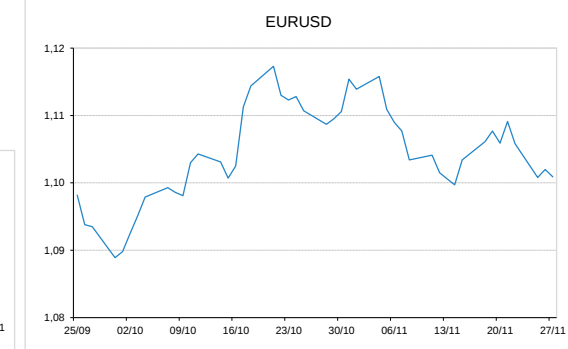
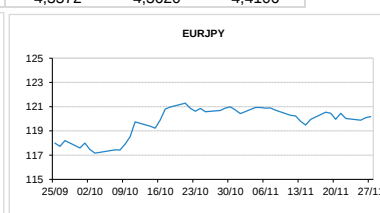


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,75	-0,52	2,02	OT 2Y	-0,514	0,02	-2,20
JETFUEL	627,82	8,24	-6,18	OT 5Y	-0,117	0,01	3,40
DIESEL	593,50	7,75	-8,60	OT 10Y	0,381	0,01	12,90
COBRE	5.943,00	56,00	-1,00	BUND 10Y	-0,819	0,62	-4,60
ZINCO	2.321,75	19,25	-215,25	SCHATZ 2Y	0,002	0,00	2,00
OURO	1.455,05	-5,11	-47,70	T-NOTE 10Y	2,634	2,60	-2,60
TRIGO	529,25	-1,75	5,75	T-NOTE 2Y	2,124	4,02	2,10
LICENÇA C02	25,17	0,79	0,20	GILT 10Y	0,594	4,64	-2,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1009	-0,10%	-0,70%	1,1077	1,1140	1,1262
EUR/GBP	0,8545	0,31%	1,03%	0,8572	0,8599	0,8654
EUR/JPY	120,18	-0,07%	0,42%	120,18	120,18	120,18
EUR/CHF	1,0997	-0,03%	0,43%	1,0988	1,0978	1,0960
EUR/BRL	4,6866	-0,31%	-5,46%	4,7316	4,7747	4,8951
EUR/PLN	4,3097	-0,11%	-0,86%	4,3372	4,3620	4,4106



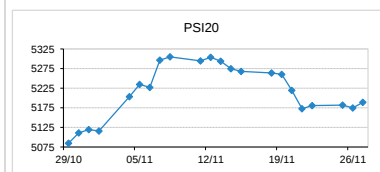
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1009	0,8545	120,18	1,0997	10,5412	7,4713	1,4616	1,62263	4,6866	10,0876
USD	0,9091	-	0,7767	109,365	0,9991	9,5893	6,7924	1,3283	1,4748	4,2607	9,1759

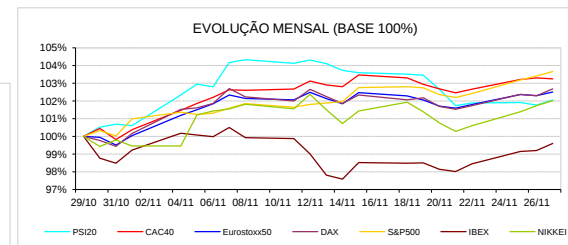
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,665	-0,53	-2,33
BCP	0,205	2,04	-10,68
CORT. AMORIM	10,740	0,56	19,33
CTT	3,102	-0,19	5,30
EDP	3,693	1,04	21,12
EDP R	9,990	-0,50	28,49
GALP	14,870	-0,47	7,79
IBERSOL	7,400	0,00	-6,33
J MARTINS	14,775	0,24	42,89
MOTA ENGIL	1,949	-1,27	21,06
NAVIGATOR	3,542	-2,15	-1,61
NOS	4,974	1,02	-6,06
NOVABASE	2,820	-1,05	46,71
PHAROL	0,109	-1,09	-33,33
RAMADA	6,100	-0,65	-18,67
REN	13,740	-0,87	4,89
SEMAPA	0,806	0,25	-5,06
SONAE CAP.	0,919	0,00	13,40
SONAE SGPS	6,100	-0,65	-18,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	2,04
EDP	1,04
NOS	1,02
CORT. AMORIM	0,56
SEMAPA	0,25
REN	-0,87
NOVABASE	-1,05
PHAROL	-1,09
MOTA ENGIL	-1,27
NAVIGATOR	-2,15



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.188,90	0,27%	9,67%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.926,84	-0,05%	25,28%	5.966,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.712,85	0,20%	23,70%	3.733,45	2.908,70
XTRA DAX	13.287,07	0,38%	25,84%	13.374,27	10.279,20
S&P 500	3.148,12	0,24%	25,58%	3.148,17	2.346,58
IBEX 35	9.362,70	0,41%	9,63%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.437,77	0,28%	17,10%	23.608,06	18.948,58



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.